

信息披露 Disclosure

(上接B049版)

客户服务热线：9536
网址：http://www.guosen.com.cn/
(6)广东南海证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：曾少林
联系人：林生迎
电话：0755-82946023
传真：0755-82943636
客户服务热线：4008881119;95656
网址：http://www.nwsec.com.cn/
(68)广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址：广东省广州市天河区大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：黄炎
联系人：黄莹
电话：020-87558888
传真：020-87565305
客户服务热线：95577或致电各地营业网点
网址：http://www.gf.com.cn/
(69)中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市深南中路7088号招商银行大厦A层
办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-84868088
传真：010-84882660
客户服务热线：010-84888888
网址：http://www.cscitic.com/

(70)中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
法定代表人：陈有安
田薇
电话：010-66569430
传真：010-66568990
客户服务热线：4008888888
网址：http://www.chinastock.com.cn/
(71)海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
联系人：李奕鸣
电话：4008888001
021-63002722
04523
网址：http://www.htsec.com/

(72)申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层
法定代表人：陈健
联系人：曹海林、曹静
电话：021-96251615
021-33388224
客户服务热线：95623或4008895523
网址：http://www.swywg.com/

(73)兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄五道广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
田薇
电话：021-38665785
021-38665783
客户服务热线：4008881123
网址：http://www.xysec.com.cn/
(74)长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路98号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路98号长江证券大厦
法定代表人：李伟
联系人：李良
电话：027-65799999
027-65841300
客户服务热线：95579、4008-888-999
网址：http://www.95579.com.cn/
(75)安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、29层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、29层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82255651
0755-82583635
客户服务热线：4008001001
网址：http://www.essence.com.cn

(76)西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
联系人：张煜
电话：023-63786633
023-63786212
客户服务热线：4008906086
网址：http://www.swsc.com.cn
(77)中印证券(浙江)有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22、23层
办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22、23层
法定代表人：沈强
联系人：姚辉
电话：0571-86087713
0571-86782905
客户服务热线：0571-95548
网址：http://www.biguan.com.cn/
(78)湘财证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
联系人：钟康峰
电话：021-68634518-9503
021-68689398
客户服务热线：4008881151
网址：http://www.xcsc.com.cn/
(79)万联证券有限责任公司
注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人：张建雄
联系人：刘世雄
电话：020-23282686
020-22377118-1013
客户服务热线：4008881133
网址：http://www.wlzq.com.cn

(80)国元证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市寿春路179号
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：李蔚
联系人：李蔚
电话：0651-2227101
0651-2227100
客户服务热线：全国统一热钱4008887777、安徽省内热钱96088
网址：http://www.gyzq.com.cn/
(81)渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区滨水西道9号
法定代表人：杜庆平
联系人：胡天彤
电话：022-28451861
022-28451892
客户服务热线：4006515988
网址：http://www.bhzq.com.cn

(82)华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
陈琳慧
电话：025-84457771
025-84579763
客户服务热线：95577
网址：http://www.htsc.com.cn/
(83)山西证券股份有限公司
注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：魏斌
联系人：张斌
电话：0351-8689669
0351-8689619
客户服务热线：4090861618
网址：http://www.i618.com.cn/
(84)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层
法定代表人：吴忠斌
联系人：吴忠超
电话：0632-8022326
0632-8022805
客户服务热线：95548
网址：http://www.citicsec.com/

(85)东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B12-15层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B12-15层
法定代表人：徐勇
联系人：陈瑞华
电话：010-66555316
010-66555246
客户服务热线：4008888993
网址：http://www.dxzq.net/
(86)东吴证券股份有限公司
注册地址：江苏省苏州观前街181号
办公地址：江苏省苏州市观前街15号
法定代表人：吴永亮
联系人：方晓丹
电话：0512-65581136
0512-65580821
客户服务热线：4002001555
网址：http://www.dwzq.com.cn/
(87)信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
电话：010-63089695
010-63089689
客户服务热线：4008008899
网址：http://www.cindasc.com

(88)东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：胡劲松
电话：021-63233888
021-63236729
客户服务热线：95650
网址：http://www.dfzq.com.cn/
(89)方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华国际大厦22-24层
法定代表人：高志毅
联系人：范志
电话：0731-85832503
0731-85832214
客户服务热线：0731-85832214
网址：http://www.founders.com

(90)长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区福中三路特区报业大厦14、16、17层
办公地址：深圳市福田区福中三路特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄巍华
联系人：黄巍华
电话：0755-83516394
0755-83516199
客户服务热线：4006666888
网址：http://www.cgw.com.cn/
(91)光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：刘晨
电话：021-22169811
021-22169134
客户服务热线：400888788;95526
网址：http://www.ebscn.com/
(92)广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江东路5号广州国际金融中心主层19层、20层
办公地址：广州市天河区珠江东路5号广州国际金融中心主层19层、20层
法定代表人：林治浩
联系人：林治浩
电话：020-88939699
020-88939644
客户服务热线：020-9613003
网址：http://www.gzs.com.cn/
(93)东北证券股份有限公司
注册地址：吉林省长春市自由大路1138号
办公地址：吉林省长春市自由大路1138号
法定代表人：郭正

联系人：潘博
电话：4006-000-686
0431-85067965
客户服务热线：0431-85096709
网址：http://www.jiasecn.com
(94)国联证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人：步国辉
联系人：潘博
电话：025-52310669
025-52310686
客户服务热线：4000258988
网址：http://www.glsc.com.cn
(95)上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号
办公地址：上海市西藏中路336号
法定代表人：龚德雄
联系人：张瑾
电话：021-62680830
0400819181_021-962518
网址：www.962518.com
(96)新时代证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市朝阳区东三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
联系人：孙旭
电话：010-82361000
010-83561001
客户服务热线：4006898988
网址：www.xsdzq.com
(97)大同证券经纪有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：太原市长治路111号山西世贸中心A座P12、P13
法定代表人：董泽祥
联系人：薛建
电话：0351-4130322
0351-4120933
客户服务热线：4007-881212
网址：http://www.dtsbc.com.cn
(98)国联证券股份有限公司
注册地址：无锡市太湖新城168号
办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街9号国联金融大厦702室
法定代表人：范奕
联系人：沈刚
电话：0610-82831662
0610-82830162
客户服务热线：400885288(全国)、0510-82588168(无锡)
网址：http://www.glsc.com.cn

(99)浙商证券股份有限公司
注册地址：杭州市杭大路15号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址：杭州市杭大路15号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人：吴承根
联系人：张智
电话：021-64718888
0571-87901913
客户服务热线：0571-967777
网址：http://www.ztc.com.cn/
(100)平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：薛海丽
电话：0755-22626172
0755-22400862
客户服务热线：4008011618
网址：http://www.pingan.com/
(101)华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市蜀山区两环路969号财富中心B1座
法定代表人：李工
联系人：甘霖
电话：0651-65161821
0651-65161872
客户服务热线：0651-96518/400896518
网址：http://www.hazq.com.cn
(102)渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第一大街79号
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦7楼
法定代表人：张维锋
联系人：武斌
电话：0755-83707413
0755-83700206
客户服务热线：4008881000(全国)、96100(广西)
网址：http://www.bhzq.com.cn
(103)财通证券股份有限公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：蔡兵
联系人：郭晓
电话：0731-84403319
0731-84403439
客户服务热线：0731-84403360
网址：http://www.ctzq.com.cn/
(104)东瑞证券有限责任公司
注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：张运勇
联系人：梁健伟
电话：0769-22111041
0769-22116993
客户服务热线：0769-961130
网址：http://www.drgzq.com.cn
(105)中原证券股份有限公司
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：菅明军
联系人：程月梅
电话：0371-65585670
0371-65585665
客户服务热线：0371-9677121;4008139666
网址：http://www.zysec.com.cn/
(106)东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：江苏省常州市东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：李永波
联系人：王源
电话：021-20333333
021-54989825
客户服务热线：95531、4008898988
网址：http://www.longone.com.cn
(107)中银国际证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：许刚
联系人：王彬
电话：021-68604866
021-95372744
客户服务热线：4006208888;021-61195666
网址：http://www.bocic.com.cn
(108)恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：刘汝军
联系人：张洪亮
电话：0471-4913968
0471-4930707
客户服务热线：0471-4961259
网址：http://www.htsc.com.cn/
(109)国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市永叔路15号
办公地址：江西省南昌市江西路88号江信国际金融大厦
法定代表人：裘强
联系人：周茂传
电话：0791-6285337
0791-6285296
客户服务热线：0791-9516168
网址：http://www.gsstock.com/
(110)华西证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市陕西街239号
办公地址：四川省成都市陕西街239号
法定代表人：吕龙云
联系人：戴莉娟
电话：021-32223888
021-68728703
客户服务热线：021-63400678
网址：http://www.wazq.com.cn
(117)光大证券股份有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道光大大厦三十、三十一层
办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：吴晓
联系人：吴晓
电话：0755-83007159
0755-83007034
客户服务热线：4000-188-688
网址：http://www.ebscn.com.cn
(138)信达证券股份有限公司
注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
法定代表人：侯建峰
联系人：刘亚娜
电话：0311-66006393
0311-66006249
客户服务热线：4008122888
网址：http://www.xindax.com.cn
(139)大通证券股份有限公司
注册地址：辽宁省大连市中山区人民路24号
办公地址：辽宁省大连市中山区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：谢立军
联系人：谢立军
电话：0411-39673219
0411-39673219
客户服务热线：4008169169
网址：http://www.daton.com.cn
(140)太平洋证券股份有限公司
注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址：北京市西城区北展北街9号华远企业D座三层
法定代表人：李长伟
联系人：陈廷
电话：0671-68888858
0671-68889100
客户服务热线：400-665-0999
网址：http://www.tpyzq.com/

1、登记机构
博时基金管理有限公司(内聘基金管理人)
3、律师事务所
名称：国浩律师集团(北京)事务所
注册地址：北京市西城区阜成门内大街27号恒润大厦9层
办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层
电话：010-65717888
010-65717800
联系人：黄伟国
经办律师：黄伟国、陈辉
4、会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展恒大厦7楼
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中国总部11楼
法人代表：杨绍钧
联系电话：(021)23238888
经办注册会计师：薛薇、沈兆杰、沈兆杰
联系人：沈兆杰

博时基金资产管理公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合业绩截至2014年9月30日，本投资组合所列时期数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	471,493,365.87	30.92
其中：	股票	471,493,365.87	30.92
2	固定收益投资	748,709,684.00	49.11
其中：	债券	748,709,684.00	49.11
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	164,000,296.00	10.76
其中：	买断式转贴现	-	-
6	应收利息	123,667,542.87	8.11
7	其他资产	16,262,977.51	1.06
8	合计	1,524,643,866.25	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	65,538,546.00	0.42
B	采矿业	-	-
C	制造业	179,562,052.44	11.29
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	13,055,543.46	0.86
E	建筑业	92,933,513.70	6.15
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	53,030.00	0.00
J	金融、软件和信息技术服务业	188,532,786.67	12.48
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药、保健和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	471,493,365.87	31.21

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	25,434,361	63,331,588.60	4.19
2	601988	中信银行	23,209,210	33,907,354.00	4.16
3	601399	工商银行	15,312,584	42,320,875.78	4.13
4	600068	贵州茅台	10,995,700	48,136,489.09	3.19
5	000060	广发股份	2,261,777	38,254,031.30	2.53
6	601668	中国建筑	11,007,758	37,316,299.62	2.47
7	605050	中航国际	4,538,824	35,001,356.72	2.32
8	002646	普华永道	1,477,626	26,109,651.42	1.73
9	002470	华信资本	680,347	16,928,277.51	1.12
10	602211	顺大国际	1,439,746	16,139,526.66	1.07

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	国债逆回购	-	-
3	地方政府债	336,907,000.00	22.30
4	企业债	336,907,000.00	22.30
5	金融债	411,802,684.00	27.26
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	合计	787,709,684.00	49.56

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140358	14债035	1,000,000	101,120,000.00	6.97
2	110241	11国债14	600,000	59,916,000.00	3.69
3	090044	09国债04	500,000	51,965,000.00	3.44
4	120023	12国债23	500,000	49,310,000.00	3.26
5	120044	12国债44	500,000	49,310,000.00	3.26

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本组合本报告期末未持有资产支持证券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本组合本报告期末未持有贵金属。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本组合本报告期末未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本组合本报告期末未持有股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本组合本报告期末未持有国债期货。

11.投资组合报告附注

11.1.报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定投资范围的股票。

11.2.报告期内基金投资的前十名债券中，没有投资超出基金合同规定投资范围的债券。

11.3.其他各项资产投资

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	440,719.50
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	16,162,617.70
5	应收申购款	179,640.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,782,977.51

11.4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本组合本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本组合本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.6.投资组合报告附注的其他文字说明部分是否存在因于四舍五入的原因，导致合计与各项目之和存在误差。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来业绩。投资有风险，投资者在做出投资决策前请仔细阅读基金的招募说明书。

十四、费用概览

期间	①净值增长率	②净值增长率-业绩比较基准收益率	③业绩比较基准收益率	④-①	④-②
2006.5.31-2006.12.31	32.30%	0.75%	19.72%	0.60%	12.58%
2007.1-2007.12.31	97.99%	1.44%	53.97%	1.09%	44.62%
2008.1-2008.12.31	-26.25%	1.05%	-31.34%	1.25%	5.82%
2009.1-2009.12.31	51.50%	1.18%	26.33%	0.28%	15.71%
2010.1-2010.12.31	2.76%	1.03%	-1.63%	0.70%	4.39%
2011.1-2011.12.31					